

オプションディレクトツールキットの
基本的な使用方法
(チャートギャラリー編)

片岡俊博

本機能について

- 楽天RSSは不必要
- 225先物／オプションのデータが入っているチャートギャラリーが必要
- 過去データの閲覧及び、過去のシミュレーションするのに、本機能を使用
- ATM-IV日足のチャートなどの表示にも、必要な機能
- 本資料の基本的な使用方法における、ポジション入力の順番は自由な順番で入力できる



OptionCareシートの画面構成(左)

Make Month Rakuten	Make Weekly Rakuten RSS	Smile Curve	Profit & Loss Chart	Read Nikkei V	Calculation	Automatic	Profit & Loss Chart Date	2017/09/05 00:07	Active Base	Confirm Profit & Loss	+0														
Month Elements	Futures Position				Futures Price						Call Position				Put Position										
Profit Process	SQ Date	Days Term	Work Day	Futures Lot	Futures Position	Futures Price	Futures Change	Risk Benefit	Sum Lot	Sum Pos Price	Sum Now Price	Risk Benefit	Delta	Vega	Gamma	Theta	Sum Lot	Sum Pos Price	Sum Now Price	Risk Benefit	Delta	Vega	Gamma	Theta	
+0	2017/11/11	0.74	0.74			22900	-45	+0.0	+0	+0	+0	+0	+0.00	+0	+0.0000%	+0.0	+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0000%		
	2017/11/11	28.74	19.74			22900	-45	+0.0	+0	+0	+0	+0	+0.00	+0	+0.0000%	+0.0	+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0000%		
The Day	2017/11/11	63.74	40.74			22850	-50	+0.0	+0	+0	+0	+0	+0.00	+0	+0.0000%	+0.0	+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0000%		
17/11/9 15:15:00	←	⇒	Read Parm	+0.0				+0.0	+0	+0	+0	+0	+0.00	+0	+0.0000%	+0.0	+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.0000%		
1 Call Position	1 Call Info				SP	1 Put Info				Greeks				1 Put Position	2 Call Position				2 Call Info						
Lot	Price	Delta	Price	Tick	Volume	Strike	Delta	Volume	Open Interest	IV	IV Change	Vega	Gamma	Theta	Lot	Price	Delta	Price	Tick	Volume	Strike	Delta	Price	Tick	Volume
						25,000																			
						24,750																			
						24,500																			
	1.0				5.8	1,220	-99.4%	1351.0	0.0	1	41.3%	0.2	0.0000%	-6.0											
	1.0				19.1	1,580	-99.3%	1101.0	1.0	5	34.7% +12.9%	0.2	0.0000%	-5.7											
	1.0				22.4	542	-99.2%	976.0	0.0	0	31.2% +11.7%	0.3	0.0000%	-5.6											
	0.9%	1.0			58.3	2,003	-99.1%	851.0	0.0	2	27.8% +10.5%	0.3	0.0000%	-5.5											
	1.0%	1.0			77.4	981	-99.0%	726.0	0.0	0	24.2% +9.3%	0.3	0.0086%	-5.3											
	1.1%	1.0			172.7	2,600	-98.9%	601.0	423.2	20	20.6% +6.8%	0.4	0.0114%	-5.1											
	1.4%	1.0			165.6	2,519	-98.6%	476.0	0.0	0	16.9% +3.7%	0.4	0.0163%	-4.9											
	1.7%	1.0			193.5	3,338	-98.3%	351.0	4697.7	12	13.0% +0.0%	0.5	0.0200%	-4.6											
	11.8%	11.0			901.1	1,906	-88.1%	236.0	5342.8	11	15.0% +2.6%	2.5	0.0200%	-2.4											
	28.5%	31.0			2409.1	3,838	-71.5%	131.0	7482.9	761	13.9% +2.3%	4.3	0.0200%	-2.8											
	55.7%	85.0			1551.2	4,829	-44.3%	60.0	3572.3	4,822	14.3% +1.2%	5.0	0.2193%	-21.5											
	77.2%	177.0			1313.0	5,139	-22.8%	27.0	2115.2	3,366	16.2% +2.0%	3.8	0.1487%	-9.6											
	87.5%	290.0			845.5	2,005	-12.5%	15.0	824.4	2,349	19.2% +4.0%	2.6	0.0852%	-4.3											

- 1.スマイルカーブの表示ボタン
- 2.損益図の表示ボタン
- 3.先物建玉枚数入力セル
- 4.先物建玉価格入力セル
- 5.期近コール建玉枚数
- 6.期近コール建玉価格
- 7.期近プット建玉枚数
- 8.期近プット建玉価格
- 9.第二限月コール建玉枚数
- 10.第二限月コール建玉価格
- 11.理論値で損益図の日付
- 12.コール建玉のリスクパラメーター
- 13.プット建玉のリスクパラメーター

OptionCareシートの画面構成(右)

2 Greeks			2 Put Position		3 Call Position		3 Call Info				SP	3 Put Info				3 Greeks			3 Put Position					
Vega	Gamma	Theta	Lot	Price	Lot	Price	Delta	Price	Tick	Volume	Open Interest	Strike Price	Delta	Price	Tick	Volume	Open Interest	IV	IV Change	Vega	Gamma	Theta	Lot	Price
9.3	0.0117%	-4.1					12.6%	105.0		15.1	225	25,000	-87.4%	2255.0		0.0	0	18.6%	+3.1%	19.3	0.0119%	-3.9		
11.9	0.0151%	-5.1					15.1%	130.0		14.2	81	24,750	-84.9%	2030.0		0.0	0	18.3%	+2.7%	21.9	0.0137%	-4.3		
14.3	0.0187%	-5.7					18.1%	160.0		38.4	2,963	24,500	-81.9%	1810.0		0.0	0	18.0%	+2.7%	24.5	0.0157%	-4.6		
17.3	0.0229%	-6.5					23.4%	235.0		38.2	1,588	24,250	-76.6%	1635.0		0.0	0	19.1%	+4.1%	28.6	0.0172%	-5.3		
18.8	0.0251%	-6.8					26.6%	265.0		157.3	2,468	24,000	-73.4%	1415.0		0.0	0	18.2%	+3.7%	30.6	0.0194%	-5.2		
20.4	0.0270%	-7.2					31.1%	320.0		50.0	2,717	23,750	-68.9%	1220.0		0.0	6	17.9%	+3.7%	32.9	0.0212%	-5.2		
21.8	0.0288%	-7.3					33.0%	335.0		68.6	134	23,625	-67.0%	1110.0		0.0	0	17.2%	+2.0%			-5.6		
23.1	0.0305%	-7.4					36.8%	415.0		92.7	3,320	23,500	-63.2%	1065.0		0.0	5	18.4%	+3.6%			-5.2		
24.1	0.0322%	-7.2					39.3%	450.0		2.0	4,025	23,375	-60.7%	975.0		1.2	0	18.1%	+3.2%			-5.1		
25.0	0.0326%	-7.2					41.7%	470.0		6.7	1,979	23,250	-58.3%	870.0		87.5	0	17.4%	+2.9%			-4.7		
25.3	0.0329%	-7.1					44.2%	485.0		0.9	77	23,125	-55.8%	760.0		5.0	5	16.4%	+1.9%			-4.3		
25.3	0.0329%	-7.1					41.1%	620.0		3.8	6,638	23,000	-51.9%	770.0		67.0	600	18.6%	+4.6%	37.1	0.0233%	-4.6		
25.3	0.0329%	-7.1									3,326	22,875					519							
25.3	0.0329%	-7.1								0.0	7,946	-22,750	-46.2%	720.0		16.6	304	20.7%	+4.7%			-4.7		
25.3	0.0329%	-7.1								0.6	12	-22,625	-42.9%	520.0		15.5	7	16.9%	+1.0%			-4.7		
25.3	0.0329%	-7.1								0.6	4,910	-22,500	-41.5%	665.0		31.6	1,545	22.5%	+6.3%			-4.5		
23.6	0.0280%	-4.2								0.0	34	-22,375	-37.2%	440.0		7.4	307	17.7%	+1.3%	35.2	0.0222%	-3.1		

OptionCareシートの画面構成(真中上)

Sum Position							
Sum Lot	Sum Pos Price	Sum Now Price	Risk Benefit	Delta	Vega	Gamma	Theta
+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.00	+0.0	+0.0000%	+0.0
+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.00	+0.0	+0.0000%	+0.0
+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.00	+0.0	+0.0000%	+0.0
+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.00	+0.0	+0.0000%	+0.0

- 14. 第二限月プット建玉枚数
- 15. 第二限月プット建玉価格
- 16. 第三限月コール建玉枚数
- 17. 第三限月コール建玉価格

- 18. 第三限月プット建玉枚数
- 19. 第三限月プット建玉価格
- 20. 先物オプション合計リスクパラメーター



Position Holdingシートの画面構成

Position Uniting						
Futures Price		Theory Date		SQ Date		Profit & Loss Chart
22,250.00		2017/9/5 00:07:30		2017/12/8 09:00		
Low Profit & Loss Price		High Profit & Loss Price		Round Price		Step Price
23	17,000		24	21,000		200
Copy Option Care Sheet						
Position Holdings						
Type	SQ Day	SP	Lot	Price	IV	Balance
0_N			+1.0	0		
1_F	2017/12/8 9:00		+0.1	22,285.00		
2_C	2017/12/8 9:00	22,500	+1.0	300	16.57%	0
3_P	2017/12/8 9:00	21,500	+1.0	170	19.57%	0
3_P	2017/12/8 9:00	21,000	-3.0	95	21.20%	0
2_C	2018/1/12 9:00	23,750	-2.0	125	16.41%	-35
3_P	2018/1/12 9:00	21,500	-1.0	340	18.65%	-35
3_P	2018/1/12 9:00	21,000	+3.0	225	19.64%	-35

23. OptionCareシートからまとまった建玉一覧

24. 楽天RSSを最終日にするかのフラグ

25. AtmIVチャート最終日付



AtmIVDataシートの画面構成

ATM Days Chart Data & Chart Setting						
Gain Days IV Data Volume	200 Days	26	Make ATM IV Chart			
Get Rakuten RSS D	24	FALSE				
Last Date	25	2017/11/9				
ATM IV Data						
Date	Commission	1 month	2month	3month	Futures	
2017/1/23	-0.39%	17.70%	18.09%	0.17672	18920	

24.楽天RSSを最終日にするかのフラグ

25.AtmIVチャート最終日付

26.AtmIVチャートデータ作成ボタン



楽天RSSを使用しない場合

Make Month Rakuten RSS	Make Weekly Rakuten RSS	Smile Cave	Profit & Loss Chart	Read Nikkei VI	Pam DB	
Position	Month Elements			Futures Position		
Profit & Loss Process	SQ Date	Days Term	Work Day	Futures Lot	Futures Position	Futures Price
+0	2017/12/08	24.74	17.74			22285
	2018/01/12	59.74	38.74			22250
The Day	2018/02/09	87.74	58.74			22250
17/11/13 00:00:00	←	⇒	Read Pam	+0.0		

楽天RSSを使用しない時は、ボタンを削除しても構わないし、ボタンを残しておいてもいい



① 日付とポジションの入力

		Smile Cave	Profit & Loss Chart	Read Nikkei VI	Pam DB	
Position1	Month Elements			Futures Position		
Profit & Loss Process	SQ Date	Days Term	Work Day	Futures Lot	Futures Position	Futures Price
+0	2017/12/08	24.74	17.74			22285
	2018/01/12	59.74	38.74			22250
The Day	2018/02/09	87.74	58.74			22250
17/11/13 00:00:00	←	⇒	Read Pam		+0.0	

② 見たい日付を入力する
(00:00:00でも構わない)

③ Read Pamを押す

① PamDBになってい
たら、PamDBから
データ取得できる



②過去データの読み取りボタン押す

	Smile Cave	Profit & Loss Chart	Read Nikkei VI	Pam DB		
Position1	Month Elements		Futures Position			
Profit & Loss Process	SQ Date	Days Term	Work Day	Futures Lot	Futures Position	Futures Price
+0	2017/12/08	24.74	17.74			22285
	2018/01/12	59.74	38.74			22250
The Day	2018/02/09	87.74	58.74			22250
17/11/13 15:15:00	←	⇒	Read Pam	+0.0		

Read Pamを押すと、その日の
先物とOPのデータが表示され
15:15は自動で入力される



③ 順番にポジションを入力する(その1)

ロングはプラス、ショートはマイナスの数値を入力

SQ Date	Days Term	Work Day	Futures Lot	Futures Position	Futures Price
2017/12/08	24.74	17.74	+1.0	22285.00	22285
2018/01/12	59.74	38.74			22250
2018/02/09	87.74	58.74			22250

225ミニ先物のポジション入力
 ラージの場合10倍する

		32.2%	195.0	762.0	14,157	22,750
		37.1%	240.0	554.9	2,343	22,625
+1	300.0	42.3%	300.0	1037.5	14,640	22,500
		47.2%	345.0	34.9	1,079	22,375

コールの期近のポジション入力



④順番にポジションを入力する(その2)

ロングはプラス、ショートはマイナスの数値を入力

-21,625	-26.8%	190.0	191.0	1,951	18.8%	-0.9%	19.8	0.0292%	-3.0		
-21,500	-24.0%	170.0	705.3	13,280	19.6%	-0.6%	18.6	0.0265%	-2.6	+1	170.0
-21,375	-21.6%	155.0	221.8	1,853	20.4%	+0.3%	17.6	0.0239%	-2.3		
-21,250	-18.7%	130.0	234.6	10,789	20.6%	-1.4%	16.1	0.0218%	-1.9		
-21,125	-17.0%	120.0	89.5	1,607	21.5%	-0.9%	15.2	0.0197%	-1.7		
-21,000	-14.2%	95.0	437.0	16,864	21.2%	-1.0%	13.5	0.0177%	-1.3	-3	95.0

期近のプットのポジション入力

		32.2%	195.0	762.0	14,157	22,750
		37.1%	240.0	554.9	2,343	22,625
+1	300.0	42.3%	300.0	1037.5	14,640	22,500
		47.2%	345.0	34.9	1,079	22,375

コールの期近のポジション入力



⑤順番にポジションを入力する(その3)

ロングはプラス、ショートはマイナスの数値を入力

									23,870
-2	125.0	16.7%	125.0		39.0	2,840			23,750
		20.0%	165.0		28.0	112			23,625
		20.9%	165.0		138.4	4,698			23,500
		23.3%	190.0		36.4	4,037			23,375

コールの第二限月のポジション入力

-21,625	-32.2%	320.0	40.8	382	16.7%	-2.4%	31.7	0.0243%	-2.4		
-21,500	-30.9%	340.0	42.9	3,096	18.7%	+0.3%	31.2	0.0213%	-2.5		
-21,375	-26.1%	240.0	8.6	208	16.6%	-2.4%	28.8	0.0221%	-1.7		
-21,250	-26.1%	280.0	44.4	778	19.2%	-0.4%	28.8	0.0191%	-2.0		
-21,125	-24.0%	255.0	36.5	618	19.6%	-0.4%	27.5	0.0180%	-1.8		
-21,000	-21.8%	225.0	57.7	7,230	19.6%	-0.1%	26.0	0.0160%	-1.6		
-20,875	-20.0%	205.0	26.2	659	20.0%	-1.2%	24.8	0.0158%	-1.4		

第二限月のプットのポジション入力



⑥リスクパラメータを確認

Sum Lot	Sum Pos Price	Sum Now Price	Risk Benefit	Delta	Vega	Gamma	Theta
-1	+185.0	+185.0	+0.0	+0.71	+1.6	+0.0127%	-5.4
+0	+85.0	+85.0	+0.0	-0.68	+2.8	-0.0049%	+5.7
+0	+0.0	+0.0	+0.0	+0.00	+0.0	+0.0000%	+0.0
-1	+270.0	+270.0	+0.0	+0.03	+4.4	+0.0078%	+0.3

⑦損益図を出す日時を入力

Profit & Loss
Chart Date

2017/11/17 15:15



⑦損益図を出すために、先物の動く範囲を指定



①PositionHoldingシートに切り替える

損益図の先物の最安値を入力

損益図の先物の最高値を入力

Low Profit & Loss Price	High Profit & Loss Price	Round Price	Step Price
20,000	24,000	200	125.00

Copy Option Care Sheet

Position Holdings						
Type	SQ Day	SP	Lot	Price	IV	Balance
0_N			+1.0	0		
1_F	2017/12/8 9:00		+0.1	22,285		
2_C	2017/12/8 9:00	22,500	+1.0	300.00	16.57%	0
3_P	2017/12/8 9:00	21,500	+1.0	170	19.57%	0
3_P	2017/12/8 9:00	21,000	-3.0	95	21.20%	0
2_C	2018/1/12 9:00	23,750	-2.0	125	16.41%	-35
3_P	2018/1/12 9:00	21,500	-1.0	340	18.65%	-35
3_P	2018/1/12 9:00	21,000	+3.0	225	19.64%	-35



⑧ 損益図を出す日時を入力

Profit & Loss Chart Date	2017/11/17 15:15
-----------------------------	------------------

⑨ スマイルカーブと損益図を表示

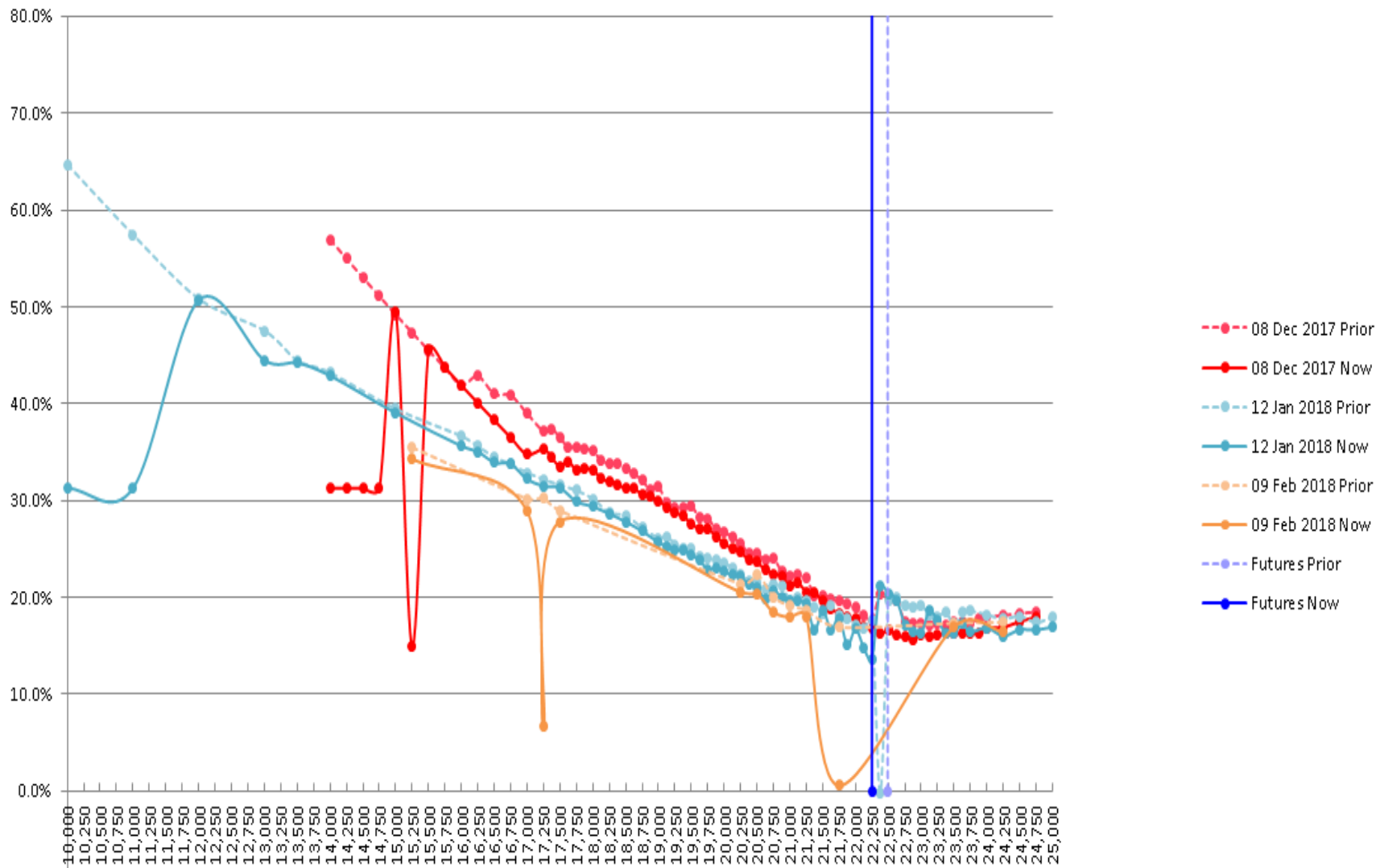
Smile Cave	Profit & Loss Chart	Read Nikkei VI
---------------	------------------------	-------------------

Smile Caveを押すと、
スマイルカーブが期近の
オプション価格表の下に
表示

Profit & Loss Chartを
押すと、損益図が、第二
限月のオプション価格表の
下に表示

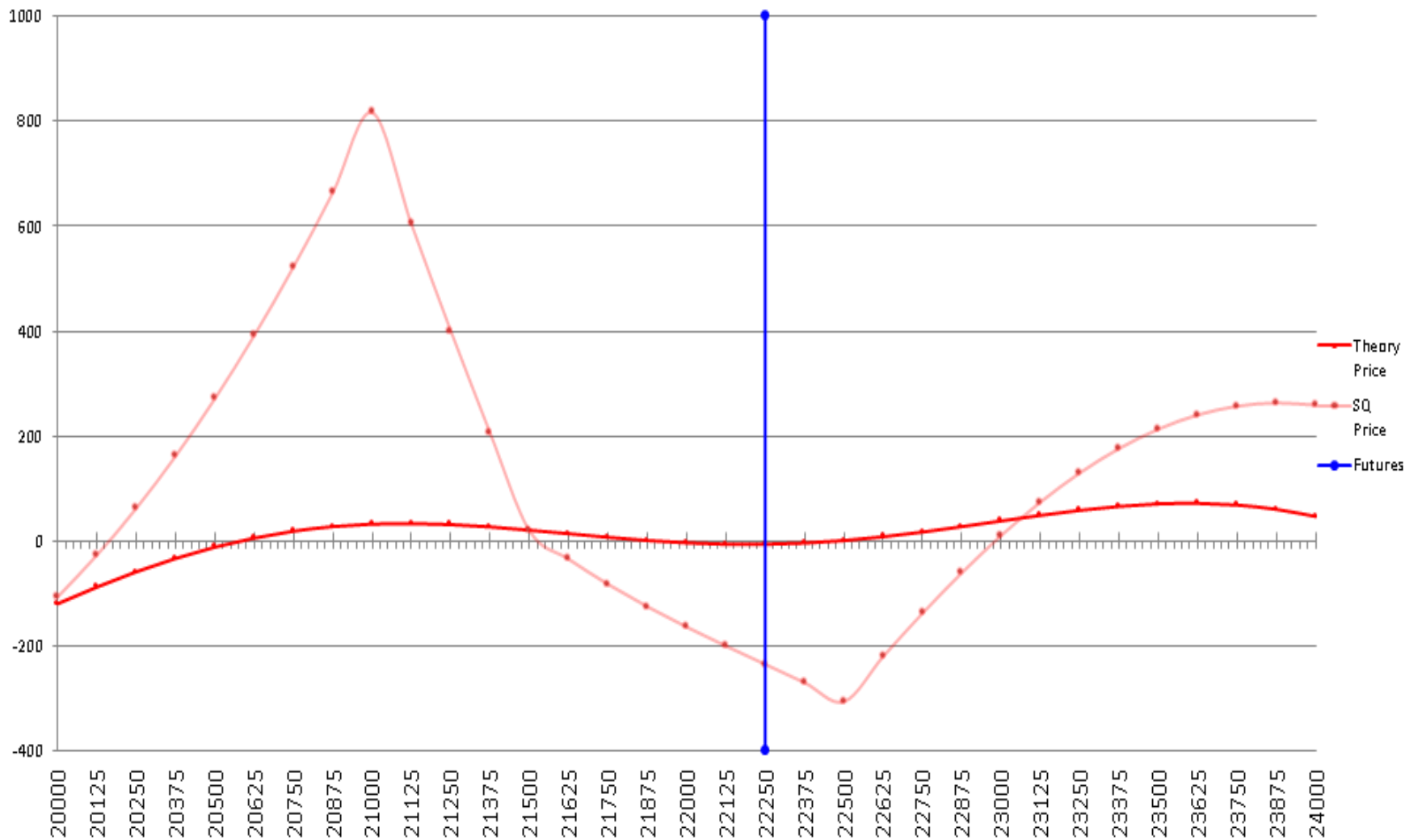


⑩スマイルカーブを表示 (表示は、期近のオプション価格表の下)



⑪損益図を表示

(表示は、第二限月のオプション価格表の下)



⑫ ATM-IVのチャートを表示

2017/3/9	-4.65%	9.95%	14.60%	0.176453	19300
Setting	OptionCare	PositionHolding	SaveSpotTime	AtmIVChart	AtmIVData

① AtmIVDataシートへ切替

ATM Days Chart Data & Chart Setting

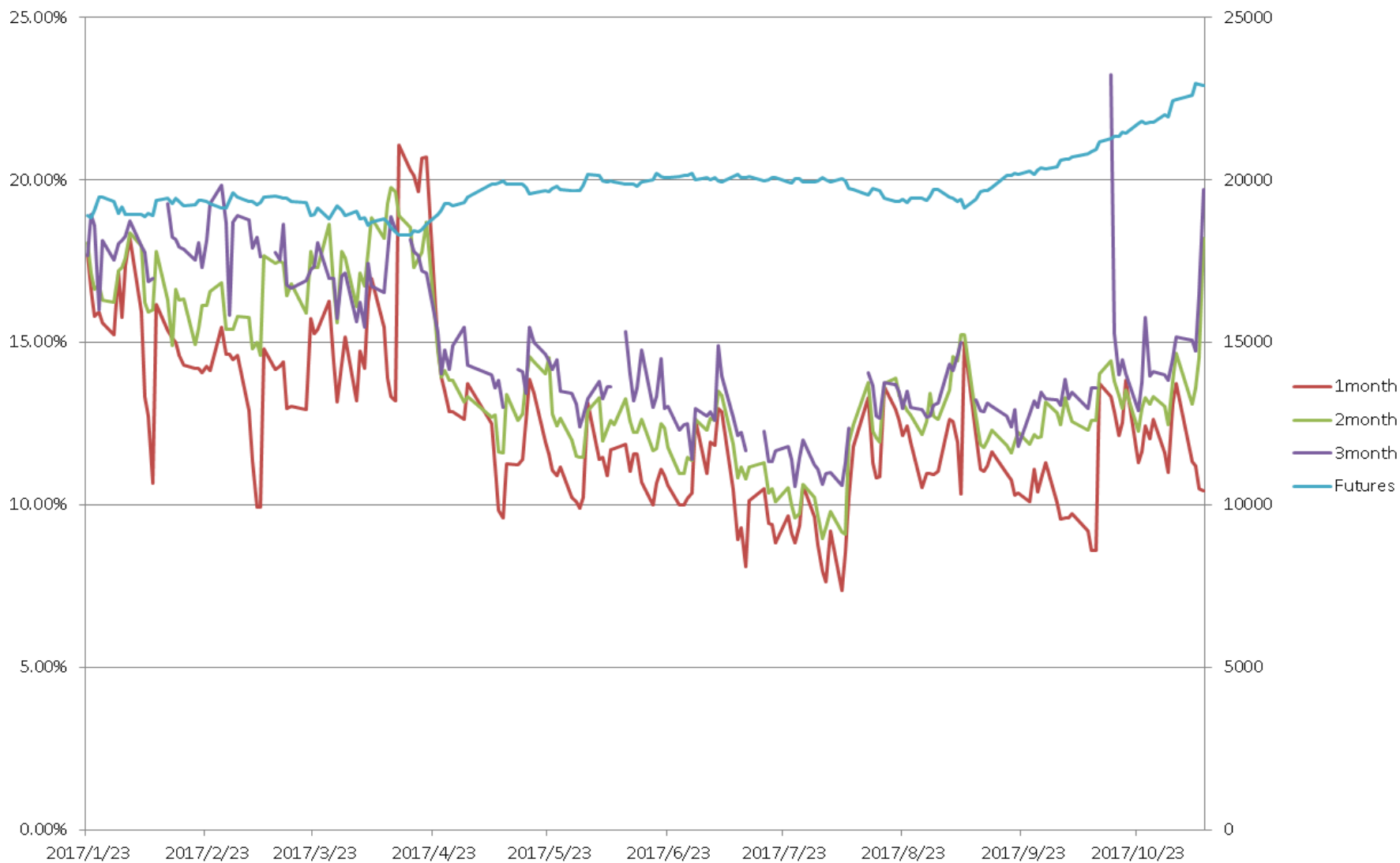
Gain Days IV Data Volume	200 Days	Make ATM IV Chart
Get Rakuten RSS Data	FALSE	
Last Date	2017/11/9	

② 表示する最終日付を入力

③ Make ATM IV Chart
を押す



⑬ ATM-IVチャート



補足 (ODTKのPDFファイルの詳細説明ページ)

- OptionCareシート 23～32ページ
- スマイルカーブ 18～19ページ
- 損益図 37～42ページ
- ATM-IVチャート 51～52ページ

